

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2013年8月24日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会有权保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。
基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细情况,应阅读半年度报告正文。

本报告中期财务资料未经审计
本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	国投瑞银成长优选股票
基金主代码	121008
交易代码	前端:121008 后端:128008
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2008年1月10日
基金管理人	国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,873,878,687.89份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金通过投资高速成长及业务有良好前景的企业,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略 本基金将采取积极的股票投资管理策略,借鉴UBSGlobal AM(瑞士银行环球资产管理公司)投资管理策略,在辅助性的主动型资产配置基础上,自上而下地精选优质成长上市公司,股票构建组合,力求实现基金资产的长期稳定增长。同时,通过严谨的风险控制管理流程,实现风险-收益的最佳匹配。
1. 类别资产配置 本基金以“自下而上”的股票精选为主,并通过适度调整类别资产的配置比例,减少基金的系统性风险。
2. 股票资产配置 本基金根据各类资产的市场趋势和预期收益风险比较判断,对股票、债券和货币市场工具等类别资产的配置比例进行动态调整,以期在投资中达到风险和收益的适当平衡。此外,本基金还将利用基金管理人长期资产管理过程中所积累的经验,根据市场突发事件、市场非有效外效应等所形成的市场波动做成本性资产配置调整。
3. 股票投资管理 本基金管理人基于基金的投资策略,在以下两方面的公司基本面分析中,挖掘优质成长企业,并使用GEVCS模型等定性评估股票的内在价值。
4. 权证投资管理 根据权证合理价值与其市场价格间的差额的“估值-定价(Value Price)”及权证与股价间定价权数的数量化,结合标的股票公允价值,决定买入、持有或卖出权证。
业绩比较基准 80%×中债标普300指数+20%×中信标普全债指数。
风险收益特征 本基金为股票型证券投资基金,属于高风险、收益高的基金品种,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型证券投资基金。

2.3 基金管理人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国投瑞银基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 刘凯 联系电话 400-880-6868 电子邮箱 service@ubssdc.com	姓名 赵会军 联系电话 010-66105799 电子邮箱 custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-880-6868	95588
传真	0755-82904448	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址: http://www.ubssdc.com
基金半年度报告备置地点:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 期间数据和指标 单位:人民币元
本期已实现收益 86,899,806.63
本期利润 -47,458,605.93
加权平均基金份额本期利润 -0.0245
本期基金份额净值增长率 -4.22%
3.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)
期末可供分配基金份额总额 -0.0843
期末基金资产净值 1,143,744,841.93
期末基金份额净值 0.6104

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.上期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润已实现部分的孰小值,仍期末余额,不是当期利润。
3.以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如封闭式基金交易佣金、开放式基金申购赎回费或基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金净值增值率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增值率②	业绩比较基准率③	业绩比较基准率④	①-③	②-④
过去一个月	-9.96%	1.71%	-12.23%	1.48%	2.27%	0.23%
过去三个月	-7.11%	1.21%	-8.85%	1.14%	1.74%	0.07%
过去六个月	-4.22%	1.17%	-8.88%	1.17%	4.66%	-
过去一年	-1.47%	1.06%	-6.75%	1.07%	5.28%	-0.01%
过去三年	-8.32%	1.10%	-8.58%	1.08%	0.26%	0.02%

自基金合同生效日起至至今 -22.49% 1.42% -46.82% 1.54% 24.33% -0.12%

注:1.本基金属于股票型基金,在实际投资组合中,本基金将维持较高的股票投资比例,即股票资产在基金资产中的占比将以基金股票资产配置比例范围60%-95%的中值,即约80%为基准,根据股票、债券等类别资产的预期风险与预期收益的综合比较与判断进行调整,为综合基金资产配置与市场指数代表性因素,本基金选用市场代表性较好的中信标普300指数和中信标普全债指数加权作为本基金的投资业绩评价基准,具体为80%×中信标普300指数+20%×中信标普全债指数。
2.本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。
3.本基金转型以来基金基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:截至本报告期末各项资产配置比例分别为股票资产占基金净值比例90.34%,权证投资占基金净值比例8.90%,债券投资占基金净值比例3.52%,现金和到期日不超过1年的政府债券占基金净值比例6.40%,符合基金合同的相关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经营情况

国投瑞银基金管理有限公司(简称“公司”),原中融基金管理有限公司,经中国证券监督管理委员会批准,于2002年6月13日正式成立,注册资本1亿元人民币。公司是第一家外方控股比例达到40%的合资基金管理公司,公司股东为国投信托有限公司(国家开发投资公司的全资子公司)及瑞士银行股份有限公司 UBS AG。公司拥有完善的市场治理结构,建立了有效的风险管理与控制机制,以“诚信、客户至上、包容性、社会责任”作为公司的文化。截止2013年6月底,公司员工141人,其中86人具有硕士或博士学位;公司管理20只基金,其中中级2只创新型基金。

4.2 基金经理 核心基金经理小组及基金经理助理简介

姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
蔡腾鹏	本基金基金经理	2010年6月29日	-	10	中国籍,硕士,具有基金从业资格,曾任华林证券研究员,泰信基金高级研究员和基金营销助理,2009年4月加入国投瑞银,曾任国投瑞银核心企业基金基金经理。
刘凯	本基金基金助理、高级研究员	2011年11月18日	-	9	中国籍,硕士,具有基金从业资格,曾任国信证券、国信弘信投资管理有限公司,2011年5月加入国投瑞银。

注:任职日期和离任日期均指公司作出决定后正式对外公告之日。证券从业的含义遵从行业协会对从业人员资格管理的相关规定。
4.2 基金管理人报告期内基金运作遵规守信情况的说明
在报告期内,本基金管理人遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金合同》等有关规定,本着恪守诚信、审慎勤勉、忠实尽职的原则,为基金份额持有人的利益管理和运用基金资产。在报告期内,基金的投资决策规范,基金运作合法合规,没有损害基金份额持有人的利益的行为。
4.3 基金管理人报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,管理人通过制度、流程和技术手段保证了公平交易原则的实现,确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监控,形成了有效地公平交易体系。本报告期内,基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行,未发现存在违反公平交易原则的情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本基金于本报告期内不存在异常交易行为。
基金管理人管理的所投资组合在本报告期内未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况。
4.4 基金管理人报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
上半年,股市场结构特征显著,新一届领导人开始接受更远的经济增长速度,同时加大对地方固定资产投资的效果,这对中国经济的长远发展是非常有利的,但同时也意味着短期内必须承受经济调整带来的压力。在这样的背景下,以沪深300为代表的大量蓝筹指数持续下跌。投资者纷纷转向以创业板、中小板为代表的符合经济转型方向的新兴产业。从行业表现上看,传媒、TMT、医药、环保等成长股中的行业涨幅居前,以煤炭、有色为代表的周期性行业表现较差。
4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
截止本报告期末,本基金份额净值0.6104元,本报告期净值增值率为-4.22%,同期业绩比较基准收益率为-8.88%,基金份额净值增长率好于业绩比较基准,主要因为本基金在上半年一直保持持有了较低的仓位,同时持有了较多的医药股,并在二季度买入了一些的大盘蓝筹股。
4.5 基金管理人宏观、证券市场和行业走势的简要展望
展望未来,我们对A股市场转向积极的态度。尽管在经济转型的大背景下,中国经济必须得为转型付出一定的代价,经济增速下降在所难免,因此市场难有好的表现。但我们

国投瑞银成长优选股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

认为上半年市场大幅下跌已经过度反应了投资者对中国经济的悲观预期,下半年随着政策预期的明确,市场存在修复性反弹的机会。在投资标的的选择上,我们倾向于大盘蓝筹股会胜出,我们也不否认复合经济转型的成长股会长期胜出。但要注意的是,过去几个月中,在所谓转型期,完成股值的估值已经到了一个不合理的水平,存在泡沫化倾向。中国经济确实在转型,符合转型方向的企业未来会出现很多牛股,但这并不意味有什么价格都可以买入,而且我们以价值投资的理念上存在很大的分歧。接下来我们会坚持两策略,即一方面继续持有低估值、行业基本面稳定的大盘蓝筹股,如地产、保险,另一方面会加大组合中成长性股的调整力度,剔除估值过高的股票,在调整中替换为估值合理的成长股。

4.6 基金管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括合规与风险控制委员会、估值小组及运营部。合规与风险控制委员会负责对估值政策进行评估,并对基金估值程序进行监督;估值小组负责跟踪执行估值政策,议定估值政策方案及特别估值程序的报告等事项;估值小组的成员包括运营部总监、估值核算员、基金核算或其他资产管理经理以及监察稽核部指定人员;运营部负责日常的基金资产的估值业务,执行基金估值政策,设立基金估值核算岗负责日常估值业务。基金管理人参与估值的相关人员均具有相应的专业胜任能力和相关工作经历。
本基金的日常估值程序由运营部基金估值核算员执行,运营部内部复核估值结果,并与托管银行的估值结果核对一致。基金估值政策的议定和修改采用集体讨论机制,基金经理作为估值小组成员,对基金估值政策的交易情况、估值核算员持有的职业审慎、向估值小组提供估值参考信息、参与估值政策讨论、对需采用特别估值程序的证券,上报合规及风险控制委员会审议后由运营部具体执行。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未与 外部估值定价服务机构签约。

4.7 基金管理人报告期内基金利润分配情况的说明
本基金本期已实现收益为86,899,806.63元,期末可供分配利润为-157,966,633.53元。本基金本期未实施利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
本报告期内,本基金托管人在对国投瑞银成长优选股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全忠实履行了基金托管人应尽的义务。
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本报告期内,国投瑞银成长优选股票型证券投资基金的托管人——国投瑞银基金管理有限公司在国投瑞银成长优选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,国投瑞银成长优选股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等情况的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司编制的和披露的国投瑞银成长优选股票型证券投资基金2013年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务数据(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:国投瑞银成长优选股票型证券投资基金
报告截止日:2013年6月30日

资产	附注号	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
银行存款	-	71,615,386.70	125,359,643.33
结算备付金	-	1,563,297.87	1,799,284.44
交易保证金	-	588,286.34	1,634,835.84
买入返售金融资产	-	1,073,446,220.45	1,104,489,794.49
其中:股票投资	-	1,033,212,760.55	1,038,199,445.89
基金投资	-	-	-
债券投资	-	40,233,459.90	66,290,348.60
资产支持证券投资	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	67,830,461.75
应收证券清算款	-	2,889,820.45	-
应收利息	-	107,128.72	390,591.05
应收申购款	-	135,928.63	67,465.76
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	-	-	-
资产总计	-	1,150,346,069.16	1,301,572,076.66

负债和所有者权益 附注号 本期末 2013年6月30日 上年度末 2012年12月31日
负债:
短期借款 - -
交易性金融负债 - -
衍生金融负债 - -
卖出回购金融资产款 - -
应付证券清算款 2,281,948.92 23,746,573.40
应付赎回款 790,709.32 219,428.09
应付管理人报酬 1,493,267.71 1,532,122.47
应付托管费 248,877.98 255,353.72
应付销售服务费 - -
应付交易费用 1,228,588.19 1,528,341.86
应付利息 10,000.00 10,000.00
应付利息 - -
递延所得税负债 - -
其他负债 547,835.11 947,121.79
负债合计 6,601,227.23 28,238,941.33
所有者权益:
实收资本 854,722,824.38 911,362,085.87
未分配利润 289,022,017.55 361,971,049.46
所有者权益合计 1,143,744,841.93 1,273,333,135.33
负债和所有者权益总计 1,150,346,069.16 1,301,572,076.66

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.6104元,基金份额总额1,873,878,687.89份。
6.2 利润表
会计主体:国投瑞银成长优选股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-	-31,720,952.59	52,710,427.59
1.利息收入	-	2,338,762.46	4,231,603.82
其中:存款利息收入	-	800,193.76	1,218,663.62
债券利息收入	-	615,086.32	2,090,283.76
资产支持证券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	923,482.38	922,416.43
其他利息收入	-	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-	100,281,183.91	-133,373,292.61
其中:股票投资收益	-	93,038,549.89	-139,993,215.34
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	-	4,431.15	-687,735.81
资产支持证券投资收益	-	-	-
衍生工具收益	-	-	-
股利收益	-	7,238,202.87	7,307,658.54
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-	-134,358,412.56	181,709,867.69
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	17,513.60	142,248.69
减:二、费用	-	15,737,653.34	21,744,449.74
1.管理人报酬	-	9,461,119.35	13,536,404.44
2.托管费	-	1,576,853.23	2,256,067.36
3.销售服务费	-	-	-
4.交易费用	-	4,479,944.43	5,731,371.50
5.利息支出	-	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-	-
6.其他费用	-	219,736.33	220,606.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-	-219,736.33	220,606.44
减:所得税费用	-	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-	-47,458,605.93	30,965,977.85

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:国投瑞银成长优选股票型证券投资基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

项目	附注号	本期2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、期初所有者权益(基金净值)	-	911,362,085.87	1,273,333,135.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-47,458,605.93	-47,458,605.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-56,639,261.49	-25,490,425.98
其中:1.基金申购款	-	12,713,585.93	5,611,875.28
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-	-69,352,847.42	-31,102,301.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	854,722,824.38	289,022,017.55

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额净值0.6104元,基金份额总额1,873,878,687.89份。
6.4 报表附注
6.4.1 基金基本情况
国投瑞银成长优选股票型证券投资基金是根据原融基金证券投资基金(以下简称“基金融”)基金合同约定于2007年12月17日审议通过 关于融基金证券投资基金转型有关事项的议案)并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]344号《关于核准融基金证券投资基金份额持有人大会决议的批复》核准,由原基金融基金转型而来。原基金融基金为契约型封闭式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期限至2008年2月止。根据深交所深证基[2008]1号《关于同意融基金证券投资基金终止上市的批复》,原基金融基金于2008年1月9日终止上市并予以登记。自2008年1月10日起,原基金融基金上市,原基金融基金更名为国投瑞银成长优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)。本基金为契约型开放式基金,于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市。
6.4.2 基金主要会计政策和会计估计
本基金的基金管理人为国投瑞银基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。
原基金融基金于基金合同失效前日经审计的基金资产净值为1,868,797,783.97元,已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原融基金证券投资基金份额分拆结果的公告》,本基金于2008年2月4日进行了基金份额折算,分拆比例为:1.219238913,并于2008年2月13日进行了变更登记。

国投瑞银成长优选股票型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

募集人民币2,871,783,866.07元,其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计人民币1,524,885.15元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字[2008]第012号审计报告予以验证。上述集中申购募集资金已按2008年2月4日基金份额拆分后的基金份额净值1.0000元折合为2,871,783,866.07份基金份额,其中集中申购资金利息折合1,524,885.15份基金份额,并于2008年2月13日进行了确认和登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行的上市股票和债券,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资比例及基金资产的60%-95%、债券投资比例及基金资产的比例为0-40%、权证投资占基金资产净值的比例不超过3%、现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:80%×中信标普300指数 + 20%×中信标普全债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础
本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国投瑞银成长优选股票型证券投资基金基金合同》和《证券投资基金信息披露管理办法》和中国证监会发布的有关法规,并参照其他有关规定进行编制。

6.4.3 本报告期末资产负债表及其他有关规定的说明
本基金2013年半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明
本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。
6.4.5 会计差错更正的说明
本基金在本期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项
根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关税收问题的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税问题的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
Q 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。
Q 对基金在证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。
Q 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内 含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年 含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
Q 基金卖出股票按0.14%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花

税。
6.4.7 关联方关系
6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
于2013年上半年度,并无与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。
6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

关联方名称	与本基金的关系
国投瑞银基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。
6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费
单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,461,119.35	13,536,404.44
其中:支付销售机构的客户维护费	1,893,625.74	1,756,123.50

注:支付基金管理人 国投瑞银基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日管理人报酬=前一日基金资产净值x1.50%÷当年天数。
6.4.8.2.2 基金托管费
单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,576,853.23	2,256,067.36

注:支付基金托管人 中国工商银行股份有限公司 的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值x0.25%÷当年天数。
6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 含回购)交易
本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的银行间同业市场的债券 含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	25,000,000.00	25,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	25,000,000.00	-
期末持有的基金份额	-	25,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.08%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。
6.4.8.5 与关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元

关联方名称	2013年1月1日至2013年6月30日 期末余额	2013年1月1日至2013年6月30日 当期利息收入	2012年1月1日至2012年6月30日 期末余额	2012年1月1日至2012年6月30日 当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	71,615,386.70	769,434.10	194,522,514.69	1,179,457.15

注:本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行保管,按银行同业利率计息。
6.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况
本基金本期及上年度可比期间无在承销期间内参与关联方承销证券。
6.4.8.7 其他关联方交易事项的说明
本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。
6.4.9 期末持有的暂时停牌等流通受限证券
本基金本期末无因认购新发增发行证券而暂时停牌的流通受限证券。
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本基金本期末无暂时停牌而流通受限的股票。
6.4.9.3 期末资产正在回购交易中作为抵押的债券
6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购
本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。
6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购
本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。
6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况
单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,033,212,760.55	89